

# 宝盈中债 1-3 年国开行债券指数 证券投资基金清算报告

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二二年七月十四日

清算报告公告日：二〇二二年七月十五日

## 一、重要提示

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《宝盈中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当终止基金合同，并对本基金进行变现及清算程序，无需召开基金份额持有人大会，同时基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序。

截至 2022 年 6 月 24 日日终，宝盈中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，触发了《基金合同》终止的情形。宝盈基金管理有限公司自 2022 年 6 月 25 日起根据相关法律法规、《基金合同》等规定履行基金财产清算程序。

本基金自 2022 年 6 月 25 日起进入清算期，由基金管理人宝盈基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 二、基金概况

### 1、基金基本情况

基金名称	宝盈中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金	
基金简称	宝盈中债 1-3 年国开行债券指数	
基金主代码	008598	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 10 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
基金最后运作日基金份额总额（运作日后有赎回确认）	4,947,159.74 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	宝盈中债 1-3 年国开	宝盈中债 1-3 年国开行

	行债券指数 A	债券指数 C
下属分级基金的交易代码	008598	008599
基金最后运作日下属分级基金的份额总额	19,276.41 份	4,927,883.33 份

## 2、基金产品说明

投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数型基金，将采用抽样复制标的指数投资方法，实现对中债 1-3 年国开行债券指数的紧密跟踪。本基金的投资策略主要包括分层抽样策略、替代性策略、债券投资策略等。
业绩比较基准	中债-1-3 年国开行债券指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。 本基金为指数型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。

## 三、基金运作情况概述

宝盈中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2019 年 11 月 26 日中国证券监督管理委员会证监许可（2019）2516 号准予募集注册，并经 2020 年 12 月 3 日证监许可（2020）3319 号准予变更注册后募集。本基金自 2021 年 6 月 1 日起向社会公开募集，基金募集工作于 2021 年 8 月 9 日顺利结束。本次募集总额为 340,001,074.16 元人民币，有效认购户数为 243 户。上述资金于 2021 年 8 月 10 日全额划入本基金在基金托管人招商银行股份有限公司开立的宝盈中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金托管专户。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资并向中国证监会备案，《宝盈中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 8 月 10 日正式生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《宝盈中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》的有关规定，宝盈中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金出现了《基金合同》约定的终止事由。基金管理人宝盈基金管理有限公司根据《基金合同》的规定履行基金财产清算程序。本基金最后运作日为 2022 年 6 月 24 日，本基金自 2022 年 6 月 25 日起进入基金财产清算程序。

## 四、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：宝盈中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 24 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	2022 年 6 月 24 日（基金最后运作日）
<b>资 产：</b>	
银行存款	504,575.83
结算备付金	-
存出保证金	1,184.49
交易性金融资产	4,593,917.02
其中：债券投资	4,593,917.02
应收利息	-
<b>资产合计：</b>	<b>5,099,677.34</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>2022 年 6 月 24 日（基金最后运作日）</b>
<b>负 债：</b>	
应付管理人报酬	514.74
应付托管费	171.58
应付销售服务费	341.85
其他负债	75,341.00
<b>负债合计：</b>	<b>76,369.17</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	4,947,159.74
未分配利润	76,148.43
<b>所有者权益合计：</b>	<b>5,023,308.17</b>
<b>负债和所有者权益总计：</b>	<b>5,099,677.34</b>

注：报告截止日 2022 年 6 月 24 日（基金最后运作日），基金份额总额为 4,947,159.74 份；其中宝盈中债 1-3 年国开行债券指数 A 基金份额总额 19,276.41 份，基金份额净值 1.0169 元；宝盈中债 1-3 年国开行债券指数 C 基金份额总额 4,927,883.33 份，基金份额净值 1.0154 元。

## 五、清算情况

自 2022 年 6 月 25 日至 2022 年 7 月 12 日止的清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，具体清算情况如下：

### 1、清算费用

按照《宝盈中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

## 2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日的银行存款为人民币 504,575.83 元，其中 504,556.19 元为存储于基金托管人招商银行股份有限公司的活期银行存款，19.64 元为应计活期银行存款利息；

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 0.00 元；

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 1,184.49 元，其中 1,184.29 元为存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金，0.20 元为应计上海证券交易所存出保证金利息；

(4) 本基金最后运作日债券投资为人民币 4,593,917.02 元，该类资产在清算期全部变现，变现金额为人民币 4,594,532.99 元。

## 3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 514.74 元，该款项已于 2022 年 7 月 5 日划出；

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 171.58 元，该款项已于 2022 年 7 月 5 日划出；

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 341.85 元，该款项已于 2022 年 7 月 5 日划出；

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币 75,341.00 元，其中：

应付汇划费为人民币 20.00 元，该款项已于 2022 年 7 月 7 日扣除；

应付交易费用为人民币 554.50 元，该款项已于 2022 年 7 月 11 日扣除；

预提 2022 年 2 季度和 2022 年 7 月中央国债登记结算有限责任公司账户维护费为人民币 6,000.00 元，基金管理人于 2022 年 7 月 6 日完成该账户注销，该款项已于 2022 年 7 月 11 日扣除；

预提信息披露费为人民币 40,000.00 元，该款项已于 2022 年 7 月 12 日扣除；

预提审计费为人民币 28,766.50 元，该款项将于实际支付时扣除。

## 4、清算期间的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2022 年 6 月 24 日基金净资产	<b>5,023,308.17</b>
加：清算期间（2022 年 6 月 25 日至 2022 年 7 月 12 日）收入	567.17
其中：利息收入-银行存款利息收入（注 1）	108.75
利息收入-上海存出保证金利息收入（注 1）	0.45
债券投资变现收益（注 2）	457.97
减：清算期间（2022 年 6 月 25 日至 2022 年 7 月 12 日）应付款项	5,003,070.18
其中：基金份额赎回产生的基金净值变动（注 3）	5,002,920.12
预估银行汇划费（注 4）	20.00
银行汇划费	130.06
二、清算结束日（2022 年 7 月 12 日）基金资产净值（注 5）	20,805.16

注 1：利息收入系以当前适用利率预估，该金额可能与实际结息金额存在略微差异。

注 2：债券投资变现收益为人民币 457.97 元，债券投资变现应付未付的银行间交易手续费为 158.00 元，于 2022 年 7 月 11 日支付。

注 3：本基金最后运作日为 2022 年 6 月 24 日，基金份额持有人在该日提交的有效赎回申请，基金管理人在 2022 年 6 月 27 日对其所申请的赎回份额进行确认，并在 2022 年 6 月 29 日支付赎回款。

注 4：截至 2022 年 7 月 12 日，预计后续支付预提审计费及清盘款项将产生 20.00 元划款手续费，该费用将于实际支付时扣除。

注 5：资产处置及负债清偿后，截至 2022 年 7 月 12 日本基金剩余财产为人民币 20,805.16 元，根据本基金《基金合同》的约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。清算期结束日次日至清算款划出日前一日的资金账户孳生的利息归基金份额持有人所有。

为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人可以在清算付款日以自有资金先行垫付上述未结息金额，供清盘分配使用，待实际资金到账后再返还基金管理人，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有，利息收入预估金额与实际结算金额的差额由基金管理人承担。

#### 5、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证券监督管理委员会备案并根据《基金合同》的要求进行公告。

## 六、备查文件

### 1、备查文件目录

(1)《宝盈中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金清算审计报告》

(2)《上海源泰律师事务所关于宝盈中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金清算事宜之法律意见》

### 2、存放地点

基金管理人的住所和/或办公场所。

### 3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的住所和/或办公场所或在基金管理人网站免费查阅。

宝盈中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金财产清算小组

2022 年 7 月 14 日（清算报告出具日期）